

DUNAS SELECCIÓN USA ESG CUBIERTO FI

Nº Registro CNMV: 4672

Informe Trimestral del Tercer Trimestre 2022

Gestora: 1) DUNAS CAPITAL ASSET MANAGEMENT S.G.I.I.C., S.A. **Depositario:** CECABANK, S.A. **Auditor:** DELOITTE SL

Grupo Gestora: **Grupo Depositario:** CECA **Rating Depositario:** Baa2 (Moody's)

El presente informe, junto con los últimos informes periódicos, se encuentran disponibles por medios telemáticos en www.dunascapital.com.

La Entidad Gestora atenderá las consultas de los clientes, relacionadas con las IIC gestionadas en:

Dirección

Calle FERNANFLOR, 4
28014 - Madrid
914263824

Correo Electrónico

jrodriguez@dunascapital.com

Asimismo cuenta con un departamento o servicio de atención al cliente encargado de resolver las quejas y reclamaciones. La CNMV también pone a su disposición la Oficina de Atención al Inversor (902 149 200, e-mail: inversores@cnmv.es).

INFORMACIÓN FONDO

Fecha de registro: 21/11/2013

1. Política de inversión y divisa de denominación

Categoría

Tipo de fondo:

Fondo que replica o reproduce un índice

Vocación inversora: IIC que Replica un Índice

Perfil de Riesgo: 6 (en una escala del 1 al 7)

Descripción general

Política de inversión: El objetivo de gestión consiste en replicar el índice S&P 500 ESG Total Return Net Euro Hedged, que recoge,

dentro de cada sector, las empresas de EEUU que mejor ponderación ESG tienen, excluye el 25% de empresas con la peor calificación ESG según la metodología de S&P DJI ESG, y excluye empresas que no cumplan con el Pacto Mundial de las Naciones Unidas con una desviación máxima respecto al índice del 5% anual. pudiendo para ello superar los límites generales de diversificación.

Se invertirá aproximadamente el 100% de la exposición total en renta variable de EEUU, invirtiendo en valores del índice y en derivados sobre el índice. Podrá existir concentración geográfica/sectorial según la composición del índice. La mayoría de la cartera cumple el ideario sostenible del índice. El seguimiento del índice se realizará mediante réplica física (mínimo

90% de la exposición total) y sintética (máximo 10% de la exposición total en derivados) suponiendo para los partícipes la máxima exposición a la evolución del índice, aunque la rentabilidad del fondo y del índice puede no ser similar ya que el fondo soporta comisiones y gastos. No existirá riesgo de contraparte en los derivados al intervenir una cámara de compensación.

Se invertirá en activos en dólares, no obstante, no habrá exposición a riesgo divisa, ya que, como el índice, el Fondo cubrirá mensualmente la exposición al riesgo divisa mediante derivados. La parte no destinada a replicar el índice se invertirá en liquidez y renta fija pública/privada de emisores/mercados zona Euro y OCDE, con elevada calidad crediticia (mínimo A-) o, si fuera inferior, al rating de España en cada momento, con un vencimiento inferior a 3 meses.

Operativa en instrumentos derivados

La metodología aplicada para calcular la exposición total al riesgo de mercado es el método del compromiso

Una información más detallada sobre la política de inversión del Fondo se puede encontrar en su folleto informativo.

Divisa de denominación EUR

2. Datos económicos

| | Periodo actual | Periodo anterior | 2022 | 2021 |
|--|----------------|------------------|------|-------|
| Índice de rotación de la cartera | 0,13 | 0,17 | 0,26 | 0,65 |
| Rentabilidad media de la liquidez (% anualizado) | 0,59 | 0,02 | 0,08 | -0,28 |

Nota: El período se refiere al trimestre o semestre, según sea el caso. En el caso de IIC cuyo valor liquidativo no se determine diariamente, éste dato y el de patrimonio se refieren a los últimos disponibles

2.1.a) Datos generales.

Cuando no exista información disponible las correspondientes celdas aparecerán en blanco

| CLASE | Nº de participaciones | | Nº de partícipes | | Divisa | Beneficios brutos distribuidos por participación | | Inversión mínima | Distribuye dividendos |
|---------|-----------------------|------------------|------------------|------------------|--------|--|------------------|------------------|-----------------------|
| | Periodo actual | Periodo anterior | Periodo actual | Periodo anterior | | Periodo actual | Periodo anterior | | |
| CLASE C | 14.883.102,64 | 14.918.944,34 | 158 | 157 | EUR | 0,00 | 0,00 | 100000000 | NO |
| CLASE R | 16.681,30 | 16.041,32 | 7 | 6 | EUR | 0,00 | 0,00 | | NO |
| CLASE I | 2.082.995,96 | 1.988.945,15 | 7 | 20 | EUR | 0,00 | 0,00 | | NO |

Patrimonio (en miles)

| CLASE | Divisa | Al final del periodo | Diciembre 2021 | Diciembre 2020 | Diciembre 2019 |
|---------|--------|----------------------|----------------|----------------|----------------|
| CLASE C | EUR | 291.112 | 394.093 | 323.665 | 269.985 |
| CLASE R | EUR | 206 | 288 | 13 | |
| CLASE I | EUR | 17.140 | 11.273 | | |

Valor liquidativo de la participación (*)

| CLASE | Divisa | Al final del periodo | Diciembre 2021 | Diciembre 2020 | Diciembre 2019 |
|---------|--------|----------------------|----------------|----------------|----------------|
| CLASE C | EUR | 19,5599 | 26,3823 | 20,4777 | 17,3754 |
| CLASE R | EUR | 12,3387 | 16,7323 | 13,0701 | |
| CLASE I | EUR | 8,2286 | 11,1003 | | |

(*)El valor liquidativo y, por tanto, su rentabilidad no recogen el efecto derivado del cargo individual al partícipe de la comisión de gestión sobre resultados:

Comisiones aplicadas en el período, sobre patrimonio medio

| CLASE | Sist. Imputac. | Comisión de gestión | | | | | | Base de cálculo | Comisión de depositario | | |
|---------|----------------|-------------------------|--------------|-------|--------------|--------------|-------|-----------------|-------------------------|-----------|-----------------|
| | | % efectivamente cobrado | | | | | | | % efectivamente cobrado | | Base de cálculo |
| | | Periodo | | | Acumulada | | | | Periodo | Acumulada | |
| | | s/patrimonio | s/resultados | Total | s/patrimonio | s/resultados | Total | | | | |
| CLASE C | | 0,05 | 0,00 | 0,05 | 0,13 | 0,00 | 0,13 | patrimonio | 0,01 | 0,04 | Patrimonio |
| CLASE R | | 0,23 | 0,00 | 0,23 | 0,67 | 0,00 | 0,67 | patrimonio | 0,01 | 0,04 | Patrimonio |
| CLASE I | | 0,05 | 0,00 | 0,05 | 0,15 | 0,00 | 0,15 | patrimonio | 0,01 | 0,04 | Patrimonio |

2.2 Comportamiento

Cuando no exista información disponible las correspondientes celdas aparecerán en blanco

A) Individual CLASE C .Divisa EUR

| Rentabilidad (% sin anualizar) | Acumulado 2022 | Trimestral | | | | Anual | | | |
|-----------------------------------|----------------|-----------------|--------|--------|--------|---------|---------|---------|---------|
| | | Último trim (0) | Trim-1 | Trim-2 | Trim-3 | Año t-1 | Año t-2 | Año t-3 | Año t-5 |
| Rentabilidad IIC | -25,86 | -6,66 | -17,02 | -4,29 | 12,21 | | | | |
| Desviación con respecto al índice | 0,01 | 0,01 | 0,01 | 0,01 | 0,01 | | | | |

| Rentabilidades extremas (i) | Trimestre actual | | Último año | | Últimos 3 años | |
|-----------------------------|------------------|------------|------------|------------|----------------|-------|
| | % | Fecha | % | Fecha | % | Fecha |
| Rentabilidad mínima (%) | -4,43 | 13-09-2022 | -4,43 | 13-09-2022 | | |
| Rentabilidad máxima (%) | 2,86 | 19-07-2022 | 3,01 | 24-06-2022 | | |

(i) Sólo se informa para las clases con una antigüedad mínima del periodo solicitado y siempre que no se haya modificado su vocación inversora

Se refiere a las rentabilidades máximas y mínimas entre dos valores liquidativos consecutivos.

La periodicidad de cálculo del valor liquidativo es *diaria*

Recuerde que rentabilidades pasadas no presuponen rentabilidades futuras. Sólo se informa si se ha mantenido una política de inversión homogénea en el período.

| Medidas de riesgo (%) | Acumulado 2022 | Trimestral | | | | Anual | | | |
|--|----------------|-----------------|--------|--------|--------|---------|---------|---------|---------|
| | | Último trim (0) | Trim-1 | Trim-2 | Trim-3 | Año t-1 | Año t-2 | Año t-3 | Año t-5 |
| Volatilidad(ii) de: | | | | | | | | | |
| Valor liquidativo | 24,51 | 22,04 | 29,12 | 21,81 | 14,16 | | | | |
| Ibex-35 | 20,56 | 16,45 | 19,79 | 24,95 | 18,01 | | | | |
| Letra Tesoro 1 año | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | |
| S&P 500 ESG | 24,25 | 21,59 | 29,19 | 21,55 | 13,86 | | | | |
| VaR histórico del valor liquidativo(iii) | 11,70 | 11,70 | 10,66 | 9,41 | 9,02 | | | | |

(ii) Volatilidad histórica: Indica el riesgo de un valor en un periodo, a mayor volatilidad mayor riesgo. A modo comparativo se ofrece la volatilidad de distintas referencias. Sólo se informa de la volatilidad para los períodos con política de inversión homogénea.

(iii) VaR histórico del valor liquidativo: Indica lo máximo que se puede perder, con un nivel de confianza del 99%, en el plazo de 1 mes, si se repitiese el comportamiento de la IIC de los últimos 5 años. El dato es a finales del periodo de referencia.

| Gastos (% s/ patrimonio medio) | Acumulado 2022 | Trimestral | | | | Anual | | | |
|--------------------------------|----------------|-----------------|--------|--------|--------|-------|------|------|------|
| | | Último trim (0) | Trim-1 | Trim-2 | Trim-3 | 2021 | 2020 | 2019 | 2017 |
| Ratio total de gastos (iv) | 0,18 | 0,06 | 0,06 | 0,06 | 0,06 | 0,22 | 0,21 | 0,21 | 0,32 |

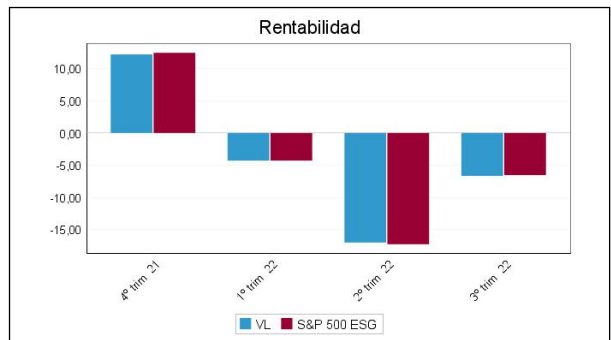
(iv) Incluye los gastos directos soportados en el periodo de referencia: comisión de gestión sobre patrimonio, comisión de depositario, auditoría, servicios bancarios (salvo gastos de financiación), y resto de gastos de gestión corriente, en términos de porcentaje sobre patrimonio medio del periodo. En el caso de fondos/compartimentos que invierten más de un 10% de su patrimonio en otras IIC este ratio incluye, de forma adicional al anterior, los gastos soportados indirectamente, derivados de esas inversiones, que incluyen las comisiones de suscripción y reembolso. Este ratio no incluye la comisión de gestión sobre resultados ni los costes de transacción por la compraventa de valores.

En el caso de inversiones en IIC que no calculan su ratio de gastos, éste se ha estimado para incorporarlo en el ratio de gastos.

Evolución del valor liquidativo últimos 5 años



Rentabilidad trimestral de los últimos 3 años



N/D "Se puede encontrar información adicional en el Anexo de este informe"

A) Individual CLASE R .Divisa EUR

| Rentabilidad (% sin anualizar) | Acumulado 2022 | Trimestral | | | | Anual | | | |
|-----------------------------------|----------------|-----------------|--------|--------|--------|---------|---------|---------|---------|
| | | Último trim (0) | Trim-1 | Trim-2 | Trim-3 | Año t-1 | Año t-2 | Año t-3 | Año t-5 |
| Rentabilidad IIC | -26,26 | -6,82 | -17,17 | -4,46 | 12,00 | | | | |
| Desviación con respecto al índice | 0,01 | 0,01 | 0,01 | 0,01 | 0,01 | | | | |

| Rentabilidades extremas (i) | Trimestre actual | | Último año | | Últimos 3 años | |
|-----------------------------|------------------|------------|------------|------------|----------------|-------|
| | % | Fecha | % | Fecha | % | Fecha |
| Rentabilidad mínima (%) | -4,44 | 13-09-2022 | -4,44 | 13-09-2022 | | |
| Rentabilidad máxima (%) | 2,86 | 19-07-2022 | 3,01 | 24-06-2022 | | |

(i) Sólo se informa para las clases con una antigüedad mínima del periodo solicitado y siempre que no se haya modificado su vocación inversora

Se refiere a las rentabilidades máximas y mínimas entre dos valores liquidativos consecutivos.

La periodicidad de cálculo del valor liquidativo es *diaria*

Recuerde que rentabilidades pasadas no presuponen rentabilidades futuras. Sólo se informa si se ha mantenido una política de inversión homogénea en el período.

| Medidas de riesgo (%) | Acumulado 2022 | Trimestral | | | | Anual | | | |
|--|----------------|-----------------|--------|--------|--------|---------|---------|---------|---------|
| | | Último trim (0) | Trim-1 | Trim-2 | Trim-3 | Año t-1 | Año t-2 | Año t-3 | Año t-5 |
| Volatilidad(ii) de: | | | | | | | | | |
| Valor liquidativo | 24,51 | 22,04 | 29,12 | 21,81 | 14,16 | | | | |
| Ibex-35 | 20,56 | 16,45 | 19,79 | 24,95 | 18,01 | | | | |
| Letra Tesoro 1 año | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | |
| S&P 500 ESG | 24,25 | 21,59 | 29,19 | 21,55 | 13,86 | | | | |
| VaR histórico del valor liquidativo(iii) | 12,27 | 12,27 | 10,75 | 7,94 | 7,05 | | | | |

(ii) Volatilidad histórica: Indica el riesgo de un valor en un periodo, a mayor volatilidad mayor riesgo. A modo comparativo se ofrece la volatilidad de distintas referencias. Sólo se informa de la volatilidad para los períodos con política de inversión homogénea.

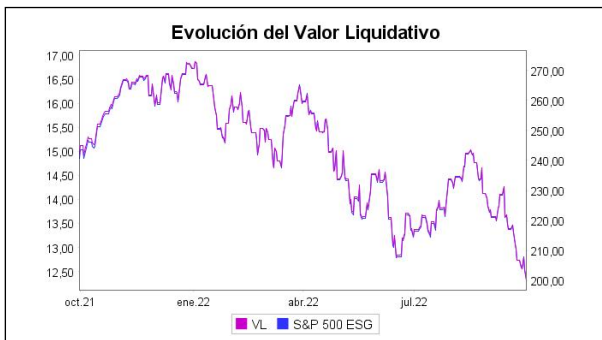
(iii) VaR histórico del valor liquidativo: Indica lo máximo que se puede perder, con un nivel de confianza del 99%, en el plazo de 1 mes, si se repitiese el comportamiento de la IIC de los últimos 5 años. El dato es a finales del periodo de referencia.

| Gastos (% s/ patrimonio medio) | Acumulado 2022 | Trimestral | | | | Anual | | | |
|--------------------------------|----------------|-----------------|--------|--------|--------|-------|------|------|------|
| | | Último trim (0) | Trim-1 | Trim-2 | Trim-3 | 2021 | 2020 | 2019 | 2017 |
| Ratio total de gastos (iv) | 0,72 | 0,24 | 0,24 | 0,24 | 0,24 | 0,94 | 0,29 | 0,00 | 0,00 |

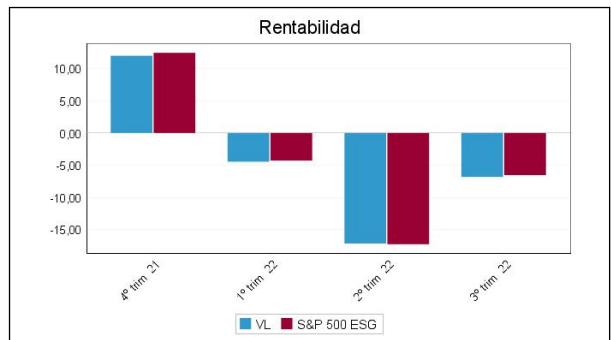
(iv) Incluye los gastos directos soportados en el periodo de referencia: comisión de gestión sobre patrimonio, comisión de depositario, auditoría, servicios bancarios (salvo gastos de financiación), y resto de gastos de gestión corriente, en términos de porcentaje sobre patrimonio medio del periodo. En el caso de fondos/compartimentos que invierten más de un 10% de su patrimonio en otras IIC este ratio incluye, de forma adicional al anterior, los gastos soportados indirectamente, derivados de esas inversiones, que incluyen las comisiones de suscripción y reembolso. Este ratio no incluye la comisión de gestión sobre resultados ni los costes de transacción por la compraventa de valores.

En el caso de inversiones en IIC que no calculan su ratio de gastos, éste se ha estimado para incorporarlo en el ratio de gastos.

Evolución del valor liquidativo últimos 5 años



Rentabilidad trimestral de los últimos 3 años



N/D "Se puede encontrar información adicional en el Anexo de este informe"

A) Individual CLASE I .Divisa EUR

| Rentabilidad (% sin anualizar) | Acumulado 2022 | Trimestral | | | | Anual | | | |
|-----------------------------------|----------------|-----------------|--------|--------|--------|---------|---------|---------|---------|
| | | Último trim (0) | Trim-1 | Trim-2 | Trim-3 | Año t-1 | Año t-2 | Año t-3 | Año t-5 |
| Rentabilidad IIC | -25,87 | -6,66 | -17,02 | -4,29 | 12,20 | | | | |
| Desviación con respecto al índice | 0,01 | 0,01 | 57,46 | 69,76 | 96,85 | | | | |

| Rentabilidades extremas (i) | Trimestre actual | | Último año | | Últimos 3 años | |
|-----------------------------|------------------|------------|------------|------------|----------------|-------|
| | % | Fecha | % | Fecha | % | Fecha |
| Rentabilidad mínima (%) | -4,43 | 13-09-2022 | -4,43 | 13-09-2022 | | |
| Rentabilidad máxima (%) | 2,86 | 19-07-2022 | 3,01 | 24-06-2022 | | |

(i) Sólo se informa para las clases con una antigüedad mínima del periodo solicitado y siempre que no se haya modificado su vocación inversora

Se refiere a las rentabilidades máximas y mínimas entre dos valores liquidativos consecutivos.

La periodicidad de cálculo del valor liquidativo es *diaria*

Recuerde que rentabilidades pasadas no presuponen rentabilidades futuras. Sólo se informa si se ha mantenido una política de inversión homogénea en el período.

| Medidas de riesgo (%) | Acumulado 2022 | Trimestral | | | | Anual | | | |
|--|----------------|-----------------|--------|--------|--------|---------|---------|---------|---------|
| | | Último trim (0) | Trim-1 | Trim-2 | Trim-3 | Año t-1 | Año t-2 | Año t-3 | Año t-5 |
| Volatilidad(ii) de: | | | | | | | | | |
| Valor liquidativo | 24,51 | 22,04 | 29,12 | 21,81 | 14,16 | | | | |
| Ibex-35 | 20,56 | 16,45 | 19,79 | 24,95 | 18,01 | | | | |
| Letra Tesoro 1 año | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | |
| S&P 500 ESG | 24,25 | 21,59 | 29,19 | 21,55 | 13,86 | | | | |
| VaR histórico del valor liquidativo(iii) | 16,29 | 16,29 | | | | | | | |

(ii) Volatilidad histórica: Indica el riesgo de un valor en un periodo, a mayor volatilidad mayor riesgo. A modo comparativo se ofrece la volatilidad de distintas referencias. Sólo se informa de la volatilidad para los períodos con política de inversión homogénea.

(iii) VaR histórico del valor liquidativo: Indica lo máximo que se puede perder, con un nivel de confianza del 99%, en el plazo de 1 mes, si se repitiese el comportamiento de la IIC de los últimos 5 años. El dato es a finales del periodo de referencia.

| Gastos (% s/ patrimonio medio) | Acumulado 2022 | Trimestral | | | | Anual | | | |
|--------------------------------|----------------|-----------------|--------|--------|--------|-------|------|------|------|
| | | Último trim (0) | Trim-1 | Trim-2 | Trim-3 | 2021 | 2020 | 2019 | 2017 |
| Ratio total de gastos (iv) | 0,19 | 0,06 | 0,06 | 0,06 | 0,06 | 0,09 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |

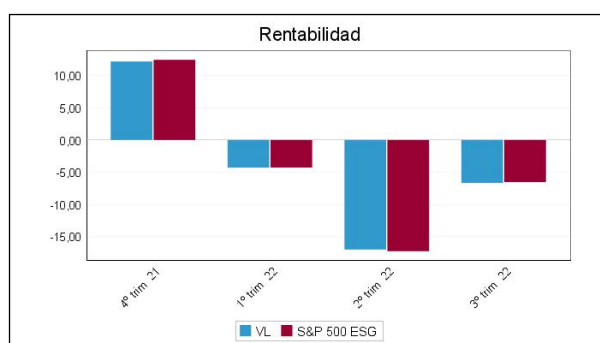
(iv) Incluye los gastos directos soportados en el periodo de referencia: comisión de gestión sobre patrimonio, comisión de depositario, auditoría, servicios bancarios (salvo gastos de financiación), y resto de gastos de gestión corriente, en términos de porcentaje sobre patrimonio medio del periodo. En el caso de fondos/compartimentos que invierten más de un 10% de su patrimonio en otras IIC este ratio incluye, de forma adicional al anterior, los gastos soportados indirectamente, derivados de esas inversiones, que incluyen las comisiones de suscripción y reembolso. Este ratio no incluye la comisión de gestión sobre resultados ni los costes de transacción por la compraventa de valores.

En el caso de inversiones en IIC que no calculan su ratio de gastos, éste se ha estimado para incorporarlo en el ratio de gastos.

Evolución del valor liquidativo últimos 5 años



Rentabilidad trimestral de los últimos 3 años



B) Comparativa

Durante el periodo de referencia, la rentabilidad media en el periodo de referencia de los fondos gestionados por la Sociedad Gestora se presenta en el cuadro adjunto. Los fondos se agrupan según su vocación inversora.

| Vocación inversora | Patrimonio gestionado* (miles de euros) | Nº de partícipes* | Rentabilidad Trimestral media** |
|--|---|-------------------|---------------------------------|
| Renta Fija Euro | 0 | 0 | 0,00 |
| Renta Fija Internacional | 0 | 0 | 0,00 |
| Renta Fija Mixta Euro | 0 | 0 | 0,00 |
| Renta Fija Mixta Internacional | 0 | 0 | 0,00 |
| Renta Variable Mixta Euro | 0 | 0 | 0,00 |
| Renta Variable Mixta Internacional | 0 | 0 | 0,00 |
| Renta Variable Euro | 8.238 | 164 | -6,40 |
| Renta Variable Internacional | 0 | 0 | 0,00 |
| IIC de Gestión Pasiva | 0 | 0 | 0,00 |
| Garantizado de Rendimiento Fijo | 0 | 0 | 0,00 |
| Garantizado de Rendimiento Variable | 0 | 0 | 0,00 |
| De Garantía Parcial | 0 | 0 | 0,00 |
| Retorno Absoluto | 942.152 | 2.532 | -0,48 |
| Global | 0 | 0 | 0,00 |
| FMM a Corto Plazo de Valor Liquidativo Variable | 0 | 0 | 0,00 |
| FMM a Corto Plazo de Valor Liq. Constante de Deuda Pública | 0 | 0 | 0,00 |
| FMM a Corto Plazo de Valor Liquidativo de Baja Volatilidad | 0 | 0 | 0,00 |
| FMM Estándar de Valor Liquidativo Variable | 0 | 0 | 0,00 |
| Renta Fija Euro Corto Plazo | 0 | 0 | 0,00 |
| IIC que Replica un Índice | 346.268 | 171 | -6,66 |

| Vocación inversora | Patrimonio gestionado* (miles de euros) | Nº de partícipes* | Rentabilidad Trimestral media** |
|--|---|-------------------|---------------------------------|
| IIC con Objetivo Concreto de Rentabilidad No Garantizado | 0 | 0 | 0,00 |
| Total fondos | 1.296.657 | 2.867 | -2,17 |

*Medias.

**Rentabilidad media ponderada por patrimonio medio de cada FI en el periodo

2.3 Distribución del patrimonio al cierre del período (Importes en miles de EUR)

| Distribución del patrimonio | Fin período actual | | Fin período anterior | |
|---|--------------------|--------------------|----------------------|--------------------|
| | Importe | % sobre patrimonio | Importe | % sobre patrimonio |
| (+) INVERSIONES FINANCIERAS | 268.538 | 87,06 | 307.205 | 92,99 |
| * Cartera interior | 0 | 0,00 | 0 | 0,00 |
| * Cartera exterior | 268.538 | 87,06 | 307.205 | 92,99 |
| * Intereses de la cartera de inversión | 0 | 0,00 | 0 | 0,00 |
| * Inversiones dudosas, morosas o en litigio | 0 | 0,00 | 0 | 0,00 |
| (+) LIQUIDEZ (TESORERÍA) | 23.111 | 7,49 | 13.769 | 4,17 |
| (+/-) RESTO | 16.809 | 5,45 | 9.393 | 2,84 |
| TOTAL PATRIMONIO | 308.458 | 100,00 % | 330.366 | 100,00 % |

Notas:

El período se refiere al trimestre o semestre, según sea el caso.

Las inversiones financieras se informan a valor e estimado de realización.

2.4 Estado de variación patrimonial

| | % sobre patrimonio medio | | | % variación respecto fin periodo anterior |
|--|------------------------------|--------------------------------|---------------------------|---|
| | Variación del período actual | Variación del período anterior | Variación acumulada anual | |
| PATRIMONIO FIN PERIODO ANTERIOR (miles de EUR) | 330.366 | 399.547 | 405.654 | |
| ± Suscripciones/ reembolsos (neto) | 0,02 | -0,35 | 2,67 | -106,78 |
| - Beneficios brutos distribuidos | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| ± Rendimientos netos | -6,35 | -18,89 | -29,39 | -67,61 |
| (+) Rendimientos de gestión | -6,23 | -18,77 | -29,03 | -68,05 |
| + Intereses | 0,00 | 0,00 | 0,01 | 319,41 |
| + Dividendos | 0,41 | 0,40 | 1,14 | -0,40 |
| ± Resultados en renta fija (realizadas o no) | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| ± Resultados en renta variable (realizadas o no) | 0,68 | -10,89 | -12,30 | -105,97 |
| ± Resultados en depósitos (realizadas o no) | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| ± Resultado en derivados (realizadas o no) | -7,35 | -8,42 | -18,06 | -15,89 |
| ± Resultado en IIC (realizados o no) | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| ± Otros resultados | 0,04 | 0,14 | 0,19 | -74,60 |
| ± Otros rendimientos | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| (-) Gastos repercutidos | -0,13 | -0,12 | -0,37 | -0,46 |
| - Comisión de gestión | -0,05 | -0,05 | -0,14 | -2,49 |
| - Comisión de depositario | -0,01 | -0,01 | -0,04 | -2,59 |
| - Gastos por servicios exteriores | 0,00 | 0,00 | -0,01 | 90,76 |
| - Otros gastos de gestión corriente | 0,00 | 0,00 | 0,00 | -23,49 |
| - Otros gastos repercutidos | -0,06 | -0,06 | -0,18 | -1,16 |
| (+) Ingresos | 0,00 | 0,00 | 0,00 | -100,00 |
| + Comisiones de descuento a favor de la IIC | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| + Comisiones retrocedidas | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| + Otros ingresos | 0,00 | 0,00 | 0,00 | -100,00 |
| PATRIMONIO FIN PERIODO ACTUAL (miles de EUR) | 308.458 | 330.366 | 308.458 | |

Nota: El período se refiere al trimestre o semestre, según sea el caso.

3. Inversiones financieras

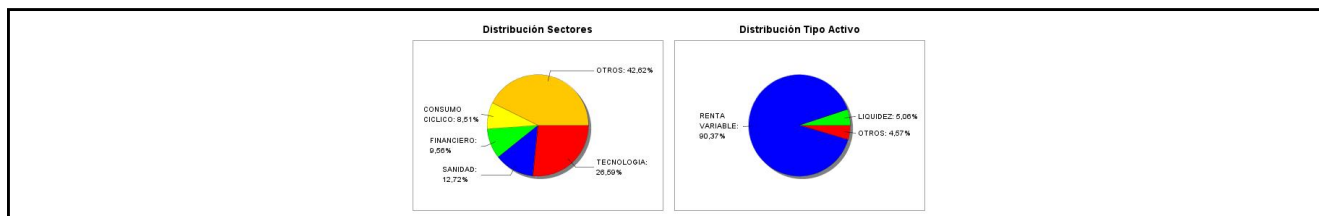
3.1 Inversiones financieras a valor estimado de realización (en miles de EUR) y en porcentaje sobre el patrimonio, al cierre del periodo

| Descripción de la inversión y emisor | Periodo actual | | Periodo anterior | |
|---|------------------|-------|------------------|-------|
| | Valor de mercado | % | Valor de mercado | % |
| TOTAL RENTA FIJA COTIZADA | 0 | 0,00 | 0 | 0,00 |
| TOTAL RENTA FIJA NO COTIZADA | 0 | 0,00 | 0 | 0,00 |
| TOTAL RF PENDIENTE ADMISION A COTIZACION | 0 | 0,00 | 0 | 0,00 |
| TOTAL ADQUISICIÓN TEMPORAL DE ACTIVOS | 0 | 0,00 | 0 | 0,00 |
| TOTAL RENTA FIJA | 0 | 0,00 | 0 | 0,00 |
| TOTAL RV COTIZADA | 0 | 0,00 | 0 | 0,00 |
| TOTAL RV NO COTIZADA | 0 | 0,00 | 0 | 0,00 |
| TOTAL RV PENDIENTE ADMISIÓN A COTIZACIÓN | 0 | 0,00 | 0 | 0,00 |
| TOTAL RENTA VARIABLE | 0 | 0,00 | 0 | 0,00 |
| TOTAL IIC | 0 | 0,00 | 0 | 0,00 |
| TOTAL DEPÓSITOS | 0 | 0,00 | 0 | 0,00 |
| TOTAL ENTIDADES DE CAPITAL RIESGO + otros | 0 | 0,00 | 0 | 0,00 |
| TOTAL INVERSIONES FINANCIERAS INTERIOR | 0 | 0,00 | 0 | 0,00 |
| TOTAL RENTA FIJA COTIZADA | 0 | 0,00 | 0 | 0,00 |
| TOTAL RENTA FIJA NO COTIZADA | 0 | 0,00 | 0 | 0,00 |
| TOTAL RF PENDIENTE ADMISION A COTIZACION | 0 | 0,00 | 0 | 0,00 |
| TOTAL ADQUISICIÓN TEMPORAL DE ACTIVOS | 0 | 0,00 | 0 | 0,00 |
| TOTAL RENTA FIJA | 0 | 0,00 | 0 | 0,00 |
| TOTAL RV COTIZADA | 278.768 | 90,36 | 316.560 | 95,83 |
| TOTAL RV NO COTIZADA | 0 | 0,00 | 0 | 0,00 |
| TOTAL RV PENDIENTE ADMISIÓN A COTIZACIÓN | 0 | 0,00 | 0 | 0,00 |
| TOTAL RENTA VARIABLE | 278.768 | 90,36 | 316.560 | 95,83 |
| TOTAL IIC | 0 | 0,00 | 0 | 0,00 |
| TOTAL DEPÓSITOS | 0 | 0,00 | 0 | 0,00 |
| TOTAL ENTIDADES DE CAPITAL RIESGO + otros | 0 | 0,00 | 0 | 0,00 |
| TOTAL INVERSIONES FINANCIERAS EXTERIOR | 278.768 | 90,36 | 316.560 | 95,83 |
| TOTAL INVERSIONES FINANCIERAS | 278.768 | 90,36 | 316.560 | 95,83 |

Notas: El período se refiere al final del trimestre o semestre, según sea el caso.

Los productos estructurados suponen un 0,00% de la cartera de inversiones financieras del fondo o compartimento.

3.2 Distribución de las inversiones financieras, al cierre del período: Porcentaje respecto al patrimonio total



3.3 Operativa en derivados. Resumen de las posiciones abiertas al cierre del periodo (importes en miles de EUR)

| Subyacente | Instrumento | Importe nominal comprometido | Objetivo de la inversión |
|---------------------------------|--|------------------------------|--------------------------|
| S&P 500 ESG INDEX | C/ FUTURO S&P500 MINI ESG 16/12/2022 | 30.465 | Inversión |
| Total subyacente renta variable | | 30465 | |
| EURO | C/ FUTURO FX EUR-USD 19/12/2022 | 3.014 | Cobertura |
| DOLAR USA | V/ Plazo | 86.909 | Cobertura |
| DOLAR USA | C/ Compromiso | 87.091 | Cobertura |
| DOLAR USA | C/ Compromiso | 256.214 | Cobertura |
| DOLAR USA | V/ Plazo | 199.653 | Cobertura |
| DOLAR USA | V/ Plazo | 84.661 | Cobertura |

| Subyacente | Instrumento | Importe nominal comprometido | Objetivo de la inversión |
|---------------------------------|-------------|------------------------------|--------------------------|
| DOLAR USA | V/ Plazo | 249.064 | Cobertura |
| Total subyacente tipo de cambio | | 966605 | |
| TOTAL OBLIGACIONES | | 997071 | |

4. Hechos relevantes

| | SI | NO |
|---|----|----|
| a. Suspensión temporal de suscripciones/reembolsos | | X |
| b. Reanudación de suscripciones/reembolsos | | X |
| c. Reembolso de patrimonio significativo | | X |
| d. Endeudamiento superior al 5% del patrimonio | | X |
| e. Sustitución de la sociedad gestora | | X |
| f. Sustitución de la entidad depositaria | | X |
| g. Cambio de control de la sociedad gestora | | X |
| h. Cambio en elementos esenciales del folleto informativo | | X |
| i. Autorización del proceso de fusión | | X |
| j. Otros hechos relevantes | | X |

5. Anexo explicativo de hechos relevantes

No aplicable.

6. Operaciones vinculadas y otras informaciones

| | SI | NO |
|--|----|----|
| a. Partícipes significativos en el patrimonio del fondo (porcentaje superior al 20%) | X | |
| b. Modificaciones de escasa relevancia en el Reglamento | | X |
| c. Gestora y el depositario son del mismo grupo (según artículo 4 de la LMV) | | X |
| d. Se han realizado operaciones de adquisición y venta de valores en los que el depositario ha actuado como vendedor o comprador, respectivamente | X | |
| e. Se han adquirido valores o instrumentos financieros emitidos o avalados por alguna entidad del grupo de la gestora o depositario, o alguno de éstos ha actuado como colocador, asegurador, director o asesor, o se han prestado valores a entidades vinculadas. | | X |
| f. Se han adquirido valores o instrumentos financieros cuya contrapartida ha sido otra una entidad del grupo de la gestora o depositario, u otra IIC gestionada por la misma gestora u otra gestora del grupo. | | X |
| g. Se han percibido ingresos por entidades del grupo de la gestora que tienen como origen comisiones o gastos satisfechos por la IIC. | | X |
| h. Otras informaciones u operaciones vinculadas | | X |

7. Anexo explicativo sobre operaciones vinculadas y otras informaciones

a) Partícipes significativos a 30 de Septiembre de 2022:

Partícipe 1: Partícipe (persona jurídica) con una inversión de 94,25% en el fondo.

d) Se han realizado las siguientes operaciones de divisa con el depositario

F. VALOR C/V DIVISA IMPORTE PRECIO

01/07/2022 V USD / EUR 4.000.000 1,0456

07/07/2022 V USD / EUR 7.000.000 1,0259

03/08/2022 V USD / EUR 7.900.000 1,0263

27/09/2022 V USD / EUR 4.000.000 0,9648

27/09/2022 C USD / EUR 500.000 0,9641

30/09/2022 V USD / EUR 21.000.000 0,9605

8. Información y advertencias a instancia de la CNMV

No aplicable.

9. Anexo explicativo del informe periódico

1. SITUACION DE LOS MERCADOS Y EVOLUCIÓN DEL FONDO.

a) Visión de la gestora/sociedad sobre la situación de los mercados.

En Europa, la crisis energética ha continuado intensificándose durante el trimestre; la ola de calor ha contribuido a llevar los precios del gas y la electricidad a máximos históricos. En cuanto al suministro ruso por Nordstream 1, lo que empezaron siendo cortes de suministro por motivos aparentemente de mantenimiento, terminó convirtiéndose en un corte permanente en el mes de septiembre, como respuesta a las sanciones aplicadas a Rusia. Aunque a efectos prácticos, la situación no supuso un cambio significativo ya que hasta ese momento se bombeaban niveles de gas a Europa muy reducidos, lo cierto es que el hecho de que no se establezca un momento de reapertura otorga al problema un carácter más "estructural", disparando las dudas sobre el abastecimiento a la UE y aumentando las probabilidades de ver algún tipo de medida de restricción al consumo.

Los PMI's de la Zona Euro continuaron a la baja, profundizando en septiembre la referencia composite por debajo del nivel de neutralidad de los 50 puntos. En este sentido, destacó especialmente el descenso registrado por los nuevos pedidos, que pasaron de 46.9 a 46.0, el nivel más bajo desde noviembre de 2020, en plena pandemia. Se trata, por lo tanto, de un dato plenamente compatible con un escenario de recesión en la Zona Euro, siendo Alemania una de las economías más afectadas, como consecuencia del impacto en su economía de la crisis energética.

Por su parte, los precios alcanzaron máximos desde la creación de la Zona Euro. Así el IPC de la UME del mes de septiembre se situó en el 10% (9.1% anterior) en su referencia general, donde, siguieron liderando el movimiento al alza la energía (+40.8% a/a) y los alimentos (+11.8%). De hecho, también la referencia subyacente experimentó un considerable impulso hasta el 4.8% (desde 4.3%). De esta forma, se sigue observando la creciente presión sobre el poder adquisitivo de los hogares en el conjunto de la UME, que ven reducida su capacidad de compra con el consiguiente impacto en materia de actividad.

Las elevadas lecturas de inflación han alentado a los bancos centrales a proseguir con subidas de tipos agresivas, postura que se puso de manifiesto en agosto tras el encuentro de banqueros centrales en Jackson Hole. El BCE subió tipos 75 puntos básicos en septiembre; el consenso de mercado espera otros 75 puntos básicos en octubre y subidas adicionales en diciembre y la primera mitad de 2023, hasta alcanzar un tipo terminal del 3,00% (desde el 0,75% actual). Subidas rápidas y abruptas, por lo tanto.

En EEUU, los datos de empleo, manufacturas o confianza del consumidor empiezan a dar algunos indicios de debilidad. No obstante, en materia energética están viendo su posición reforzada, incrementándose sus exportaciones a Europa tanto en cantidad como en precio. El dólar se fortalece también. En general se pone de manifiesto una situación sensiblemente mejor a la que vivimos en Europa. En estos tiempos que corren, el Treasury americano adelanta al Bund alemán como referencia en activo libre de riesgo. La inflación también prosigue al alza; si bien en septiembre experimentó una pequeña caída por la bajada en el precio de la gasolina, la inflación subyacente siguió empujando, con las partidas

vinculadas a la vivienda como mayores aportadores. Todo ello, ha alentado el discurso de la FED de seguir subiendo tipos con mano de hierro. Tras las últimas subidas los tipos se sitúan al 3,00% y el consenso de mercado es que llegarán hasta un tipo terminal del 5,00% en la primera mitad de 2023.

Mención por último a Reino Unido, destacar la enorme volatilidad generada en Reino Unido tras el anuncio de un plan fiscal por parte del gobierno de Truss por importe de 161.000 millones de libras en 5 años (más de un 7.0% del PIB nominal del 2021), que obligó al BoE a actuar en el mercado con el fin de solucionar problemas graves que se estaban produciendo en el sistema financiero inglés. Así volvió a realizar compras de deuda pública en plazos elevados y retrasó hasta el 31 de octubre el programa de venta de Gilts. A posteriori, el gobierno ha reducido ostensiblemente su plan fiscal expansivo. Allí, los tipos se sitúan en el 2,25% con expectativa de llegar al 5,00% en 2023 según consenso.

En cuanto al mercado, todo esto (contexto económico más deteriorado y tipos más altos de lo esperado) ha supuesto caídas de precios generalizadas en todas las clases de activos. En bolsa el Ibex baja un 8%, el Eurostoxx un 3,5%, el SP500 un 5% y el NASDAQ un 4%. En bonos, el Bund alemán ve incrementada en 100 puntos su rentabilidad (-10% en precio), lo mismo que el bono español, mientras que el Treasury americano la ve ampliada en 80 puntos (-8% en precio). En cuanto al crédito, ampliaciones de spread, con el high yield europeo a 10 años tocando máximos por encima de los 700 puntos y el investment grade en 160 puntos, ambos niveles los máximos alcanzados en el peor momento del COVID.

b) Decisiones generales de inversión adoptadas.

Al tratarse de un Fondo índice cuyo objetivo es replicar el índice de referencia, no se toman decisiones de inversión por parte de la Sociedad Gestora. En este aspecto, el 'tracking error' del fondo frente a su índice de referencia se situó por debajo del límite establecido.

c) Índice de referencia. La rentabilidad neta obtenida por el fondo, en el trimestre, ha sido del -6.66% en la Clase I y C, y del -6,82% de la clase R, frente a un -6.54% del benchmark.

d) Evolución del Patrimonio, participes, rentabilidad y gastos de la IIC.

El patrimonio del fondo al final del periodo es de 308,458 Mn. respecto a los 330,366 Mn. del periodo anterior. El desglose de la variación patrimonial, en tanto por ciento sobre el patrimonio medio en el período, se resumiría en un 0,02% debido a suscripciones reembolsos, un -6,23% debido a rendimientos de gestión y un -0,13% debido a gastos repercutidos al fondo. Asimismo, el número de participes se sitúa en 187.

e) Rendimiento del fondo en comparación con el resto de fondos de la gestora.

El fondo obtuvo una rentabilidad acumulada en el periodo de -6.66% en la Clase I y C y del -6,82% en la clase R, frente al -2,17% de la media de fondos gestionados por la gestora.

2. INFORMACION SOBRE LAS INVERSIONES.

a) Inversiones concretas realizadas durante el periodo.

Al tratarse de un Fondo índice cuyo objetivo es replicar el índice de referencia, no se toman decisiones de inversión por parte de la Sociedad Gestora.

Las principales aportaciones positivas en el periodo provinieron de Apple (+0.70%), Amazon (+0.49%) y Exxon Mobil (+0.13%), mientras la contribución negativa más importante para la cartera fue la cobertura de los dólares estadounidenses (-7%), Nvidia (-0.18%) y Verizon Communications (-0.15%).

b) Operativa de préstamo de valores. Ningún activo ha sido objeto de operaciones de préstamo de valores.

c) Operativa en derivados y adquisición temporal de activos.

A lo largo del trimestre se realizaron operaciones con instrumentos financieros derivados con finalidad de inversión y cobertura. La estrategia de inversión en derivados persigue, en todo momento, la consecución de una mayor o menor sensibilidad de la cartera a los movimientos de tipos de interés. A fecha fin periodo el importe comprometido en dichas posiciones era de 997.071.000 euros.

Grado de Cobertura: 0,94 Apalancamiento Medio: 16,65

d) Otra información sobre inversiones.

3. EVOLUCION DEL OBJETIVO CONCRETO DE RENTABILIDAD. 4. RIESGO ASUMIDO POR EL FONDO.

La volatilidad del fondo a lo largo del último período se ha situado en torno al 24,51% mientras que la volatilidad del

Bechmark ha sido del 24,25%.

No se han realizado inversiones al amparo del artículo 48.1.j del RIIC, ni se mantienen productos estructurados en cartera.

5. EJERCICIO DERECHOS POLITICOS.

6. INFORMACION Y ADVERTENCIAS CNMV.

7. ENTIDADES BENEFICIARIAS DEL FONDO SOLIDARIO E IMPORTE CEDIDO A LAS MISMAS.

8. COSTES DERIVADOS DEL SERVICIO DE ANALISIS.

N/A

9. COMPARTIMENTOS DE PROPOSITO ESPECIAL (SIDE POCKETS).

10. PERSPECTIVAS DE MERCADO Y ACTUACION PREVISIBLE DEL FONDO.

En los próximos meses, la evolución del mercado vendrá en buena parte marcada por la evolución de la guerra en Ucrania, la inflación y los tipos de interés, y la posibilidad de recesión económica en EEUU y Europa.

Al tratarse de un Fondo índice cuyo objetivo es replicar su índice de referencia, no se toman decisiones de inversión por parte de la Sociedad Gestora.

10. Detalle de inversiones financieras

| Descripción de la inversión y emisor | Divisa | Periodo actual | | Periodo anterior | |
|--|--------|------------------|------|------------------|------|
| | | Valor de mercado | % | Valor de mercado | % |
| Total Deuda Pública Cotizada mas de 1 año | | 0 | 0,00 | 0 | 0,00 |
| Total Deuda Pública Cotizada menos de 1 año | | 0 | 0,00 | 0 | 0,00 |
| Total Renta Fija Privada Cotizada mas de 1 año | | 0 | 0,00 | 0 | 0,00 |
| Total Renta Fija Privada Cotizada menos de 1 año | | 0 | 0,00 | 0 | 0,00 |
| TOTAL RENTA FIJA COTIZADA | | 0 | 0,00 | 0 | 0,00 |
| TOTAL RENTA FIJA NO COTIZADA | | 0 | 0,00 | 0 | 0,00 |
| TOTAL RF PENDIENTE ADMISION A COTIZACION | | 0 | 0,00 | 0 | 0,00 |
| TOTAL ADQUISICIÓN TEMPORAL DE ACTIVOS | | 0 | 0,00 | 0 | 0,00 |
| TOTAL RENTA FIJA | | 0 | 0,00 | 0 | 0,00 |
| TOTAL RV COTIZADA | | 0 | 0,00 | 0 | 0,00 |
| TOTAL RV NO COTIZADA | | 0 | 0,00 | 0 | 0,00 |
| TOTAL RV PENDIENTE ADMISIÓN A COTIZACIÓN | | 0 | 0,00 | 0 | 0,00 |
| TOTAL RENTA VARIABLE | | 0 | 0,00 | 0 | 0,00 |
| TOTAL IIC | | 0 | 0,00 | 0 | 0,00 |
| TOTAL DEPÓSITOS | | 0 | 0,00 | 0 | 0,00 |
| TOTAL ENTIDADES DE CAPITAL RIESGO + otros | | 0 | 0,00 | 0 | 0,00 |
| TOTAL INVERSIONES FINANCIERAS INTERIOR | | 0 | 0,00 | 0 | 0,00 |
| Total Deuda Pública Cotizada mas de 1 año | | 0 | 0,00 | 0 | 0,00 |
| Total Deuda Pública Cotizada menos de 1 año | | 0 | 0,00 | 0 | 0,00 |
| Total Renta Fija Privada Cotizada mas de 1 año | | 0 | 0,00 | 0 | 0,00 |
| Total Renta Fija Privada Cotizada menos de 1 año | | 0 | 0,00 | 0 | 0,00 |
| TOTAL RENTA FIJA COTIZADA | | 0 | 0,00 | 0 | 0,00 |
| TOTAL RENTA FIJA NO COTIZADA | | 0 | 0,00 | 0 | 0,00 |
| TOTAL RF PENDIENTE ADMISION A COTIZACION | | 0 | 0,00 | 0 | 0,00 |
| TOTAL ADQUISICIÓN TEMPORAL DE ACTIVOS | | 0 | 0,00 | 0 | 0,00 |
| TOTAL RENTA FIJA | | 0 | 0,00 | 0 | 0,00 |
| US0367521038 - ACCIONES ANTHEM INC | USD | 1.408 | 0,46 | 1.596 | 0,48 |
| US15135B1017 - ACCIONES ACC. CENTENE CO | USD | 574 | 0,19 | 676 | 0,20 |
| US12514G1085 - ACCIONES CDW | USD | 273 | 0,09 | 285 | 0,09 |
| JE00BJ1F3079 - ACCIONES AMCOR | USD | 220 | 0,07 | 258 | 0,08 |
| US98978V1035 - ACCIONES ZOETIS | USD | 896 | 0,29 | 1.108 | 0,34 |
| IE00BDB6Q211 - ACCIONES WILLIS TOWERS | USD | 285 | 0,09 | 339 | 0,10 |
| US9022521051 - ACCIONES TYLER TECH | USD | 199 | 0,06 | 173 | 0,05 |
| US89832Q1094 - ACCIONES TRUIST FINANCIAL | USD | 746 | 0,24 | 881 | 0,27 |
| US6556631025 - ACCIONES NORDSON | USD | 148 | 0,05 | 149 | 0,05 |
| US6081901042 - ACCIONES MOHAWK | USD | 61 | 0,02 | 91 | 0,03 |
| US60770K1079 - ACCIONES MODERNA | USD | 514 | 0,17 | 697 | 0,21 |
| US4456581077 - ACCIONES JB HUNT | USD | 168 | 0,05 | 180 | 0,05 |
| US3687361044 - ACCIONES GENERAC HOLDINGS | USD | 147 | 0,05 | 181 | 0,05 |
| US3137451015 - ACCIONES FEDERAL REALTY | USD | 85 | 0,03 | 92 | 0,03 |
| US3030751057 - ACCIONES FACTSET | USD | 196 | 0,06 | 200 | 0,06 |
| US30212P3038 - ACCIONES EXPEDIA INC | USD | 197 | 0,06 | 196 | 0,06 |
| US2371941053 - ACCIONES DARDEN RESTAURANTS | USD | 200 | 0,06 | 195 | 0,06 |
| US1598641074 - ACCIONES CHARLES RIVER | USD | 129 | 0,04 | 148 | 0,04 |
| US1488061029 - ACCIONES CATALENT | USD | 167 | 0,05 | 261 | 0,08 |
| US12769G1004 - ACCIONES CAESARS | USD | 97 | 0,03 | 108 | 0,03 |
| US44980X1090 - ACCIONES ACC. IPG PHOTON | USD | 0 | 0,00 | 50 | 0,02 |

| Descripción de la inversión y emisor | Divisa | Periodo actual | | Periodo anterior | |
|--|--------|------------------|------|------------------|------|
| | | Valor de mercado | % | Valor de mercado | % |
| US9344231041 - ACCIONES WARNER BROS DISCOVER | USD | 336 | 0,11 | 422 | 0,13 |
| US0126531013 - ACCIONES ACC. ALBEMARLE | USD | 400 | 0,13 | 324 | 0,10 |
| US3696043013 - ACCIONES GENERAL ELECTRIC | USD | 877 | 0,28 | 976 | 0,30 |
| US9892071054 - ACCIONES Zebra | USD | 175 | 0,06 | 208 | 0,06 |
| US9553061055 - ACCIONES West | USD | 235 | 0,08 | 317 | 0,10 |
| US8962391004 - ACCIONES Trimble | USD | 174 | 0,06 | 195 | 0,06 |
| US7237871071 - ACCIONES Pioneer | USD | 667 | 0,22 | 692 | 0,21 |
| US5719032022 - ACCIONES Marriott | USD | 499 | 0,16 | 494 | 0,15 |
| US56585A1025 - ACCIONES Marathon | USD | 639 | 0,21 | 641 | 0,19 |
| US4932671088 - ACCIONES keycorp | USD | 193 | 0,06 | 219 | 0,07 |
| US4606901001 - ACCIONES Interpublic | USD | 129 | 0,04 | 144 | 0,04 |
| US45687V1061 - ACCIONES Ingersoll | USD | 225 | 0,07 | 226 | 0,07 |
| US4364401012 - ACCIONES Hologic | USD | 208 | 0,07 | 233 | 0,07 |
| US43300A2033 - ACCIONES Hilton | USD | 427 | 0,14 | 412 | 0,12 |
| US3167731005 - ACCIONES Fifth | USD | 283 | 0,09 | 308 | 0,09 |
| US30225T1025 - ACCIONES Extra | USD | 299 | 0,10 | 302 | 0,09 |
| US29786A1060 - ACCIONES Etsy | USD | 173 | 0,06 | 123 | 0,04 |
| US2567461080 - ACCIONES Dollar | USD | 371 | 0,12 | 480 | 0,15 |
| US1156372096 - ACCIONES Brown-Forman | USD | 157 | 0,05 | 170 | 0,05 |
| US0905722072 - ACCIONES Bio-Rad | USD | 127 | 0,04 | 141 | 0,04 |
| US96145D1054 - ACCIONES Welltower | USD | 109 | 0,04 | 141 | 0,04 |
| US95040Q1040 - ACCIONES Vulcan | USD | 385 | 0,12 | 490 | 0,15 |
| US9290421091 - ACCIONES Vornado | USD | 52 | 0,02 | 60 | 0,02 |
| US92532F1003 - ACCIONES Verisk | USD | 959 | 0,31 | 971 | 0,29 |
| US92345Y1064 - ACCIONES Ventas | USD | 346 | 0,11 | 371 | 0,11 |
| US92276F1003 - ACCIONES Unum | USD | 207 | 0,07 | 269 | 0,08 |
| US9113631090 - ACCIONES Under | USD | 244 | 0,08 | 234 | 0,07 |
| US9026531049 - ACCIONES UDR | USD | 172 | 0,06 | 190 | 0,06 |
| US9024941034 - ACCIONES Tyson | USD | 247 | 0,08 | 337 | 0,10 |
| US8760301072 - ACCIONES Tapestry | USD | 102 | 0,03 | 113 | 0,03 |
| US8740541094 - ACCIONES Take-Two | USD | 220 | 0,07 | 190 | 0,06 |
| US8718291078 - ACCIONES Sysco | USD | 465 | 0,15 | 575 | 0,17 |
| US8574771031 - ACCIONES State | USD | 289 | 0,09 | 299 | 0,09 |
| US8545021011 - ACCIONES Stanley | USD | 154 | 0,05 | 259 | 0,08 |
| US8330341012 - ACCIONES Snap-on | USD | 139 | 0,04 | 141 | 0,04 |
| US8085131055 - ACCIONES Charles | USD | 1.417 | 0,46 | 1.306 | 0,40 |
| US8064071025 - ACCIONES Henry | USD | 116 | 0,04 | 142 | 0,04 |
| US7766961061 - ACCIONES Roper | USD | 492 | 0,16 | 552 | 0,17 |
| US75886F1075 - ACCIONES Regeneron | USD | 953 | 0,31 | 871 | 0,26 |
| US7588491032 - ACCIONES Regency | USD | 117 | 0,04 | 120 | 0,04 |
| US74834L1008 - ACCIONES Quest | USD | 185 | 0,06 | 216 | 0,07 |
| US7445731067 - ACCIONES Public | USD | 362 | 0,12 | 425 | 0,13 |
| US74340W1036 - ACCIONES Prologis | USD | 971 | 0,31 | 1.169 | 0,35 |
| US74251V1026 - ACCIONES Principal | USD | 216 | 0,07 | 221 | 0,07 |
| US74144T1088 - ACCIONES T Rowe | USD | 306 | 0,10 | 365 | 0,11 |
| US7140461093 - ACCIONES PerkinElmer | USD | 207 | 0,07 | 242 | 0,07 |
| US6937181088 - ACCIONES PACCAR | USD | 376 | 0,12 | 380 | 0,11 |
| US6935061076 - ACCIONES PPG | USD | 336 | 0,11 | 360 | 0,11 |
| US6934751057 - ACCIONES PNC | USD | 791 | 0,26 | 914 | 0,28 |
| US6826801036 - ACCIONES ONEOK | USD | 296 | 0,10 | 328 | 0,10 |
| US6687711084 - ACCIONES NortonLifeLock | USD | 166 | 0,05 | 169 | 0,05 |
| US6658591044 - ACCIONES Northern | USD | 230 | 0,07 | 267 | 0,08 |
| US6512291062 - ACCIONES Newell | USD | 69 | 0,02 | 96 | 0,03 |
| US6311031081 - ACCIONES Nasdaq | USD | 248 | 0,08 | 237 | 0,07 |
| US6200763075 - ACCIONES Motorola | USD | 483 | 0,16 | 471 | 0,14 |
| US6153691059 - ACCIONES Moody's | USD | 496 | 0,16 | 585 | 0,18 |
| US60871R2094 - ACCIONES Molson | USD | 117 | 0,04 | 136 | 0,04 |
| US5926881054 - ACCIONES Mettler-Toledo | USD | 315 | 0,10 | 353 | 0,11 |
| US58155Q1031 - ACCIONES McKesson | USD | 631 | 0,20 | 670 | 0,20 |
| US5178341070 - ACCIONES Las | USD | 159 | 0,05 | 153 | 0,05 |
| US49446R1095 - ACCIONES Kimco | USD | 147 | 0,05 | 161 | 0,05 |
| US4878361082 - ACCIONES Kellogg | USD | 229 | 0,07 | 242 | 0,07 |
| US48203R1041 - ACCIONES Juniper | USD | 120 | 0,04 | 123 | 0,04 |
| US46284V1017 - ACCIONES Iron | USD | 165 | 0,05 | 187 | 0,06 |
| US45167R1041 - ACCIONES IDEX | USD | 195 | 0,06 | 183 | 0,06 |
| US4448591028 - ACCIONES Humana | USD | 793 | 0,26 | 799 | 0,24 |
| US44107P1049 - ACCIONES Host | USD | 147 | 0,05 | 149 | 0,04 |
| US4404521001 - ACCIONES Hormel | USD | 181 | 0,06 | 177 | 0,05 |
| US42824C1099 - ACCIONES Hewlett | USD | 201 | 0,07 | 230 | 0,07 |
| US4278661081 - ACCIONES Hershey | USD | 418 | 0,14 | 416 | 0,13 |
| US42250P1030 - ACCIONES Healthpeak | USD | 160 | 0,05 | 185 | 0,06 |
| US40434L1052 - ACCIONES HP | USD | 293 | 0,09 | 477 | 0,14 |
| US37959E1029 - ACCIONES Globe | USD | 117 | 0,04 | 121 | 0,04 |
| US3119001044 - ACCIONES Fastenal | USD | 342 | 0,11 | 381 | 0,12 |

| Descripción de la inversión y emisor | Divisa | Periodo actual | | Periodo anterior | |
|--|--------|------------------|------|------------------|------|
| | | Valor de mercado | % | Valor de mercado | % |
| US3024913036 - ACCIONES FMC | USD | 185 | 0,06 | 183 | 0,06 |
| US30040W1080 - ACCIONES Eversource | USD | 349 | 0,11 | 385 | 0,12 |
| US2971781057 - ACCIONES Essex | USD | 204 | 0,07 | 226 | 0,07 |
| US29476L1070 - ACCIONES Equity | USD | 294 | 0,10 | 327 | 0,10 |
| US29444U7000 - ACCIONES Equinix | USD | 669 | 0,22 | 783 | 0,24 |
| US2855121099 - ACCIONES Electronic | USD | 395 | 0,13 | 460 | 0,14 |
| US28176E1082 - ACCIONES Edwards | USD | 662 | 0,21 | 823 | 0,25 |
| US2810201077 - ACCIONES Edison | USD | 279 | 0,09 | 319 | 0,10 |
| US2788651006 - ACCIONES Ecolab | USD | 462 | 0,15 | 508 | 0,15 |
| US2600031080 - ACCIONES Dover | USD | 216 | 0,07 | 232 | 0,07 |
| US2538681030 - ACCIONES Digital | USD | 376 | 0,12 | 487 | 0,15 |
| US23918K1088 - ACCIONES DaVita | USD | 60 | 0,02 | 71 | 0,02 |
| US2091151041 - ACCIONES Consolidated | USD | 393 | 0,13 | 446 | 0,14 |
| US2058871029 - ACCIONES Conagra | USD | 202 | 0,07 | 218 | 0,07 |
| US1729081059 - ACCIONES Cintas | USD | 431 | 0,14 | 434 | 0,13 |
| US1255231003 - ACCIONES Cigna | USD | 1.093 | 0,35 | 1.163 | 0,35 |
| US12504L1098 - ACCIONES CBRE | USD | 280 | 0,09 | 328 | 0,10 |
| US12503M1080 - ACCIONES Cboe | USD | 168 | 0,05 | 160 | 0,05 |
| US1011211018 - ACCIONES Boston Pp | USD | 138 | 0,04 | 168 | 0,05 |
| US0997241064 - ACCIONES BorgWarner | USD | 96 | 0,03 | 106 | 0,03 |
| US05722G1004 - ACCIONES Baker | USD | 274 | 0,09 | 354 | 0,11 |
| US0534841012 - ACCIONES AvalonBay | USD | 333 | 0,11 | 378 | 0,11 |
| US0527691069 - ACCIONES Autodesk | USD | 524 | 0,17 | 483 | 0,15 |
| US04621X1081 - ACCIONES Assurant | USD | 100 | 0,03 | 135 | 0,04 |
| US0404131064 - ACCIONES Arista | USD | 358 | 0,12 | 279 | 0,08 |
| US0394831020 - ACCIONES Archer | USD | 582 | 0,19 | 611 | 0,18 |
| US03743Q1085 - ACCIONES APA | USD | 144 | 0,05 | 175 | 0,05 |
| US03662Q1058 - ACCIONES ANSYS | USD | 249 | 0,08 | 277 | 0,08 |
| US0091581068 - ACCIONES AIR PRODUCTS & CHEMI | USD | 667 | 0,22 | 732 | 0,22 |
| US0010551028 - ACCIONES Aflac | USD | 417 | 0,14 | 472 | 0,14 |
| NL0009434992 - ACCIONES LyondellBasell | USD | 247 | 0,08 | 307 | 0,09 |
| LR0008862868 - ACCIONES Royal | USD | 107 | 0,03 | 104 | 0,03 |
| IE00BY7QL619 - ACCIONES Johnson | USD | 438 | 0,14 | 453 | 0,14 |
| IE00BL909M33 - ACCIONES Pentair | USD | 95 | 0,03 | 101 | 0,03 |
| IE00BK9ZQ967 - ACCIONES Trane | USD | 433 | 0,14 | 410 | 0,12 |
| IE00B8KQN827 - ACCIONES Eaton | USD | 686 | 0,22 | 686 | 0,21 |
| GB00BWFY5505 - ACCIONES Nielsen | USD | 141 | 0,05 | 111 | 0,03 |
| BMG491BT1088 - ACCIONES Invesco | USD | 66 | 0,02 | 73 | 0,02 |
| US98419M1009 - ACCIONES Xylem | USD | 203 | 0,07 | 187 | 0,06 |
| US7547301090 - ACCIONES Raymond | USD | 248 | 0,08 | 220 | 0,07 |
| US42809H1077 - ACCIONES Hess | USD | 392 | 0,13 | 388 | 0,12 |
| US0152711091 - ACCIONES Alexandria | USD | 269 | 0,09 | 287 | 0,09 |
| US02376R1023 - ACCIONES Alaska | USD | 110 | 0,04 | 109 | 0,03 |
| US1011371077 - ACCIONES Boston Sc | USD | 716 | 0,23 | 741 | 0,22 |
| US89417E1091 - ACCIONES Travelers | USD | 469 | 0,15 | 560 | 0,17 |
| US68622V1061 - ACCIONES ORGANON CO | USD | 80 | 0,03 | 117 | 0,04 |
| IE00BZ12WP82 - ACCIONES LINDE FINANCE | USD | 1.735 | 0,56 | 1.972 | 0,60 |
| US92556V1061 - ACCIONES VIATRIS INC | USD | 146 | 0,05 | 168 | 0,05 |
| US03027X1000 - ACCIONES AMERICAN TOWER CORP | USD | 1.291 | 0,42 | 1.617 | 0,49 |
| US14448C1045 - ACCIONES CARRIER GLOBAL CORP | USD | 386 | 0,13 | 1.014 | 0,31 |
| US68902V1070 - ACCIONES OTIS WORLDWIDE CORP | USD | 346 | 0,11 | 615 | 0,19 |
| US61945C1036 - ACCIONES THE MOSAIC CO. | USD | 215 | 0,07 | 232 | 0,07 |
| US0844231029 - ACCIONES WR BERKLEY CORP | USD | 170 | 0,06 | 189 | 0,06 |
| US5797802064 - ACCIONES MCCORMICK & CO-NON | USD | 231 | 0,07 | 275 | 0,08 |
| US57060D1081 - ACCIONES MARKETAXESS HOLDINGS | USD | 120 | 0,04 | 129 | 0,04 |
| US45866F1049 - ACCIONES INTERCONTINENTAL EXC | USD | 651 | 0,21 | 703 | 0,21 |
| US1720621010 - ACCIONES CINCINNATI FINANCIAL | USD | 183 | 0,06 | 309 | 0,09 |
| US21036P1084 - ACCIONES CONSTELLATION BRANDS | USD | 473 | 0,15 | 521 | 0,16 |
| US0304201033 - ACCIONES AMERICAN WATER WORKS | USD | 306 | 0,10 | 358 | 0,11 |
| US8835561023 - ACCIONES THERMO FISHER | USD | 2.566 | 0,83 | 2.762 | 0,84 |
| US22052L1044 - ACCIONES CORTEVA INC | USD | 530 | 0,17 | 528 | 0,16 |
| US2605571031 - ACCIONES DOW INC | USD | 407 | 0,13 | 511 | 0,15 |
| US9297401088 - ACCIONES WABTEC CORP | USD | 204 | 0,07 | 206 | 0,06 |
| US9182041080 - ACCIONES VF CORP | USD | 122 | 0,04 | 191 | 0,06 |
| US55354G1004 - ACCIONES MSCI INC | USD | 439 | 0,14 | 451 | 0,14 |
| JE00B783TY65 - ACCIONES APTIV PLC | USD | 274 | 0,09 | 320 | 0,10 |
| CH0044328745 - ACCIONES CHUBB LIMITED | USD | 981 | 0,32 | 1.170 | 0,35 |
| US16119P1084 - ACC. CHARTER COMMUNICATIONS | USD | 434 | 0,14 | 789 | 0,24 |
| US7512121010 - ACCIONES RALPH LAUREN CORP | USD | 59 | 0,02 | 58 | 0,02 |
| US87165B1035 - ACCIONES SYNCHRONY FINANCIAL | USD | 175 | 0,06 | 193 | 0,06 |
| US4523271090 - ACCIONES ILLUMINA INC | USD | 387 | 0,13 | 392 | 0,12 |
| US5007541064 - ACCIONES KRAFT FOODS | USD | 343 | 0,11 | 360 | 0,11 |
| US34959J1088 - ACCIONES FORTIVE | USD | 268 | 0,09 | 259 | 0,08 |
| US78409V1044 - ACCIONES S&P GLOBAL INC | USD | 1.343 | 0,44 | 1.629 | 0,49 |

| Descripción de la inversión y emisor | Divisa | Periodo actual | | Periodo anterior | |
|--|--------|------------------|------|------------------|------|
| | | Valor de mercado | % | Valor de mercado | % |
| IE00BKVD2N49 - ACCIONES SEAGATE TECHNOLOGY | USD | 145 | 0,05 | 199 | 0,06 |
| US65339F1012 - ACCIONES NEXTERA ENERGY | USD | 1.989 | 0,64 | 2.099 | 0,64 |
| US09247X1019 - ACCIONES BLACKROCK INC | USD | 1.071 | 0,35 | 1.188 | 0,36 |
| US02079K3059 - ACCIONES ALPHABET INC | USD | 7.406 | 2,40 | 8.755 | 2,65 |
| US02079K1079 - ACCIONES ALPHABET INC | USD | 6.657 | 2,16 | 8.108 | 2,45 |
| US49456B1017 - ACCIONES KINDER MORGAN | USD | 426 | 0,14 | 434 | 0,13 |
| IE00BTN1Y115 - ACCIONES MEDTRONIC | USD | 1.385 | 0,45 | 1.664 | 0,50 |
| US9314271084 - ACCIONES WALGREEN | USD | 291 | 0,09 | 361 | 0,11 |
| US6936561009 - ACCIONES PVH CORP | USD | 0 | 0,00 | 54 | 0,02 |
| US49338L1035 - ACCIONES KEYSIGHT TECHNOLOGIE | USD | 366 | 0,12 | 337 | 0,10 |
| US90184L1026 - ACCIONES TWITTER INC | USD | 381 | 0,12 | 592 | 0,18 |
| US26875P1012 - ACCIONES EOG RESOURCES | USD | 845 | 0,27 | 1.251 | 0,38 |
| US12572Q1058 - ACCIONES CME GROUP INC | USD | 822 | 0,27 | 1.020 | 0,31 |
| US37045V1008 - ACCIONES GENERAL MOTORS | USD | 604 | 0,20 | 638 | 0,19 |
| US2786421030 - ACCIONES EBAY INC | USD | 261 | 0,08 | 360 | 0,11 |
| US8288061091 - ACCIONES SIMON PROPERTY GROUP | USD | 379 | 0,12 | 414 | 0,13 |
| US0268747849 - ACCIONES AMERICAN INTERNAT | USD | 466 | 0,15 | 633 | 0,19 |
| US57636Q1040 - ACCIONES MASTERCARD INC | USD | 3.133 | 1,02 | 3.600 | 1,09 |
| US59156R1086 - ACCIONES METLIFE | USD | 526 | 0,17 | 607 | 0,18 |
| US9078181081 - ACCIONES UNION PACIFIC CORP | USD | 1.571 | 0,51 | 1.847 | 0,56 |
| US3546131018 - ACCIONES FRANKLIN RESOURCES | USD | 86 | 0,03 | 87 | 0,03 |
| US0584981064 - ACCIONES BALL Co MANUFACTURES | USD | 196 | 0,06 | 298 | 0,09 |
| US2310211063 - ACCIONES CUMMINS INC | USD | 371 | 0,12 | 369 | 0,11 |
| US00287Y1091 - ACCIONES ABBVIE INC | USD | 3.064 | 0,99 | 3.782 | 1,14 |
| US4180561072 - ACCIONES HASBRO INC | USD | 124 | 0,04 | 141 | 0,04 |
| US8725401090 - ACCIONES TXI INC | USD | 940 | 0,30 | 895 | 0,27 |
| US6092071058 - ACCIONES MONDELEZ INTERNATION | USD | 970 | 0,31 | 1.152 | 0,35 |
| US9884981013 - ACCIONES YUM BRANDS INC | USD | 391 | 0,13 | 446 | 0,13 |
| US9418481035 - ACCIONES WATERS CORP | USD | 209 | 0,07 | 270 | 0,08 |
| US8552441094 - ACCIONES STARBUCKS CORP | USD | 1.248 | 0,40 | 1.196 | 0,36 |
| US00846U1016 - ACCIONES AGILENT TECHNOLOGIES | USD | 469 | 0,15 | 479 | 0,14 |
| US0758871091 - ACCIONES BECTON DICKINSON & C | USD | 821 | 0,27 | 972 | 0,29 |
| US2003401070 - ACCIONES COMERICA INC | USD | 128 | 0,04 | 130 | 0,04 |
| US7185461040 - ACCIONES CONOCOPHILLIPS | USD | 500 | 0,16 | 525 | 0,16 |
| US67066G1040 - ACCIONES INVIDIA CORP | USD | 3.925 | 1,27 | 5.186 | 1,57 |
| US6541061031 - ACCIONES NIKE | USD | 1.356 | 0,44 | 1.734 | 0,52 |
| US0865161014 - ACCIONES BEST BUY CO INC | USD | 174 | 0,06 | 195 | 0,06 |
| US1729674242 - ACCIONES CITIGROUP | USD | 1.042 | 0,34 | 1.238 | 0,37 |
| US92826C8394 - ACCIONES VISA INC CLASS | USD | 3.751 | 1,22 | 4.389 | 1,33 |
| US2193501051 - ACCIONES CORNING INC | USD | 285 | 0,09 | 322 | 0,10 |
| US35671D8570 - ACCIONES FREEPORT MCMORAN | USD | 505 | 0,16 | 593 | 0,18 |
| US79466L3024 - ACCIONES SALESFORCE | USD | 1.848 | 0,60 | 2.129 | 0,64 |
| US3703341046 - ACCIONES GENERAL MILLS | USD | 589 | 0,19 | 607 | 0,18 |
| US58933Y1055 - ACCIONES MERCK | USD | 2.817 | 0,91 | 3.040 | 0,92 |
| US6745991058 - ACCIONES OCCIDENTAL PETROLEUM | USD | 591 | 0,19 | 694 | 0,21 |
| US0231351067 - ACCIONES AMAZON.COM INC | USD | 12.932 | 4,19 | 12.720 | 3,85 |
| US5658491064 - ACCIONES MARATHON OIL CORP | USD | 198 | 0,06 | 187 | 0,06 |
| US0640581007 - ACCIONES BK OF NY MELLON | USD | 366 | 0,12 | 417 | 0,13 |
| US91324P1021 - ACCIONES UNITEDHEALTH GROUP | USD | 6.100 | 1,98 | 6.566 | 1,99 |
| CH0102993182 - ACCIONES TYCO ELECTRONICS | USD | 456 | 0,15 | 493 | 0,15 |
| US2547091080 - ACCIONES DISCOVER FINANCIAL | USD | 321 | 0,10 | 348 | 0,11 |
| US7591EP1005 - ACCIONES REGIONS FINANCIAL | USD | 242 | 0,08 | 238 | 0,07 |
| US1266501006 - ACCIONES CVS CAREMARK CORP | USD | 1.617 | 0,52 | 1.685 | 0,51 |
| US00206R1023 - ACCIONES AT & T | USD | 1.412 | 0,46 | 2.036 | 0,62 |
| US03076C1062 - ACCIONES AMERIPRISE FINANCIAL | USD | 352 | 0,11 | 359 | 0,11 |
| US20030N1019 - ACCIONES COMCAST | USD | 1.668 | 0,54 | 2.621 | 0,79 |
| US6516391066 - ACCIONES NEWMONT MINING CORP | USD | 431 | 0,14 | 649 | 0,20 |
| US0079031078 - ACCIONES ADVANCED MICRO DEVIC | USD | 1.321 | 0,43 | 1.640 | 0,50 |
| US25179M1036 - ACCIONES DEVON ENERGY CORP | USD | 508 | 0,16 | 461 | 0,14 |
| US09062X1037 - ACCIONES BIOGEN IDEC INC | USD | 500 | 0,16 | 404 | 0,12 |
| US29364G1031 - ACCIONES ENTERGY CORP | USD | 264 | 0,09 | 301 | 0,09 |
| US1344291091 - ACCIONES CAMPBELL SOUP | USD | 123 | 0,04 | 130 | 0,04 |
| US9694571004 - ACCIONES WILLIAMS COS | USD | 450 | 0,15 | 503 | 0,15 |
| US30161N1019 - ACCIONES EXELON CORP | USD | 480 | 0,16 | 608 | 0,18 |
| US31428X1063 - ACCIONES FEDEX CORP | USD | 458 | 0,15 | 740 | 0,22 |
| US6174464486 - ACCIONES MORGAN STANLEY DEAN | USD | 1.366 | 0,44 | 1.474 | 0,45 |
| US9029733048 - ACCIONES US BANCORP | USD | 704 | 0,23 | 718 | 0,22 |
| US7458671010 - ACCIONES PULTE HOMES INC | USD | 112 | 0,04 | 137 | 0,04 |
| US03073E1055 - ACCIONES AMERISOURCEBERGEN | USD | 272 | 0,09 | 281 | 0,09 |
| US7607591002 - ACCIONES REPUBLIC SERVICES IN | USD | 361 | 0,12 | 365 | 0,11 |
| US4595061015 - ACCIONES INTL FLAVORS & FRAGR | USD | 299 | 0,10 | 414 | 0,13 |
| US4165151048 - ACCIONES HARTFORD FINANCIAL S | USD | 258 | 0,08 | 302 | 0,09 |
| US5529531015 - ACCIONES MGM MIRAGE | USD | 125 | 0,04 | 154 | 0,05 |
| US45168D1046 - ACCIONES IDEXX LABORATORIES I | USD | 350 | 0,11 | 396 | 0,12 |

| Descripción de la inversión y emisor | Divisa | Periodo actual | | Periodo anterior | |
|--|--------|------------------|--------------|------------------|--------------|
| | | Valor de mercado | % | Valor de mercado | % |
| US9633201069 - ACCIONES WHIRPOOL CORP | USD | 103 | 0,03 | 129 | 0,04 |
| US20825C1045 - ACCIONES CONOCOPHILLIPS | USD | 1.682 | 0,55 | 1.546 | 0,47 |
| US5486611073 - ACCIONES LOWE'S INC | USD | 1.550 | 0,50 | 1.586 | 0,48 |
| US5184391044 - ACCIONES ESTEE LAUDER COMPANI | USD | 646 | 0,21 | 1.001 | 0,30 |
| US8326964058 - ACCIONES JM SMUCKER CO/THE-NE | USD | 189 | 0,06 | 184 | 0,06 |
| US38141G1040 - ACCIONES GOLDMAN SACHS | USD | 1.292 | 0,42 | 1.374 | 0,42 |
| US2441991054 - ACCIONES DEERE & CO | USD | 1.199 | 0,39 | 1.166 | 0,35 |
| US00724F1012 - ACCIONES ADOBE SYSTEMS INC | USD | 1.663 | 0,54 | 2.316 | 0,70 |
| US7703231032 - ACCIONES ROBERT HALF | USD | 121 | 0,04 | 111 | 0,03 |
| US9113121068 - ACCIONES UNITED PARCEL SERVIC | USD | 1.527 | 0,49 | 1.807 | 0,55 |
| US7010941042 - ACCIONES PARKER HANNIFIN CORP | USD | 402 | 0,13 | 422 | 0,13 |
| US0378331005 - ACCIONES APPLE COMPUTER | USD | 26.958 | 8,74 | 29.005 | 8,78 |
| US14040H1059 - ACCIONES CAPITAL ONE FINANCIA | USD | 457 | 0,15 | 574 | 0,17 |
| US1264081035 - ACCIONES CSX CORP | USD | 737 | 0,24 | 870 | 0,26 |
| US14149Y1082 - ACCIONES CARDINAL HEALTH | USD | 235 | 0,08 | 201 | 0,06 |
| US3755581036 - ACCIONES GLEAD SCIENCES | USD | 998 | 0,32 | 1.075 | 0,33 |
| US7443201022 - ACCIONES PRUDENTIAL FINANCIAL | USD | 412 | 0,13 | 491 | 0,15 |
| US9621661043 - ACCIONES WEYHEAEUSER CO | USD | 273 | 0,09 | 330 | 0,10 |
| US2546871060 - ACCIONES WALT DISNEY CO | USD | 2.221 | 0,72 | 2.379 | 0,72 |
| US91913Y1001 - ACCIONES VALERO ENERGY CORP | USD | 544 | 0,18 | 595 | 0,18 |
| US6819191064 - ACCIONES OMNICOM GROUP INC | USD | 167 | 0,05 | 181 | 0,05 |
| US94106L1098 - ACCIONES WASHINGTON MUTUAL | USD | 778 | 0,25 | 805 | 0,24 |
| US7134481081 - ACCIONES PEPSICO INC | USD | 2.909 | 0,94 | 3.146 | 0,95 |
| US68389X1054 - ACCIONES ORACLE | USD | 1.198 | 0,39 | 1.497 | 0,45 |
| US5951121038 - ACCIONES MICRON TECHNOLOGY | USD | 714 | 0,23 | 827 | 0,25 |
| US5324571083 - ACCIONES ELLI LILLY | USD | 3.293 | 1,07 | 3.418 | 1,03 |
| US4523081093 - ACCIONES ILLINOIS TOOL WORKS | USD | 657 | 0,21 | 694 | 0,21 |
| US5801351017 - ACCIONES MC DONALDS CORPORATI | USD | 2.192 | 0,71 | 2.485 | 0,75 |
| US5010441013 - ACCIONES KROGER CO | USD | 368 | 0,12 | 427 | 0,13 |
| US4601461035 - ACCIONES JNT. PAPER | USD | 148 | 0,05 | 217 | 0,07 |
| US4062161017 - ACCIONES HALLIBURTON CO | USD | 288 | 0,09 | 371 | 0,11 |
| US0605051046 - ACCIONES BANK OF AMERICA CORP | USD | 2.726 | 0,88 | 3.019 | 0,91 |
| US0311621009 - ACCIONES AMGEN INC | USD | 1.557 | 0,50 | 1.983 | 0,60 |
| US0258161092 - ACCIONES AMERICAN EXPRESS COM | USD | 1.045 | 0,34 | 1.153 | 0,35 |
| US50540R4092 - ACCIONES LABORATORY CRP OF AM | USD | 239 | 0,08 | 301 | 0,09 |
| US4612021034 - ACCIONES INTUIT INC | USD | 1.411 | 0,46 | 1.422 | 0,43 |
| US1252691001 - ACCIONES CHARTER ONE FIN INC | USD | 248 | 0,08 | 245 | 0,07 |
| US5128071082 - ACCIONES LAM RESEARCH | USD | 647 | 0,21 | 777 | 0,24 |
| US87612E1064 - ACCIONES TARGET CORP | USD | 889 | 0,29 | 916 | 0,28 |
| US46625H1005 - ACCIONES JP MORGAN CHASE | USD | 3.957 | 1,28 | 4.538 | 1,37 |
| US3453708600 - ACCIONES FORD MOTOR | USD | 571 | 0,19 | 616 | 0,19 |
| US0718131099 - ACCIONES BAXTER INTL | USD | 350 | 0,11 | 447 | 0,14 |
| US5341871094 - ACCIONES LINCOLN NATL | USD | 88 | 0,03 | 110 | 0,03 |
| US5717481023 - ACCIONES MARSH & MCLEAN | USD | 962 | 0,31 | 1.065 | 0,32 |
| US92343V1044 - ACCIONES VERIZON COMMUN. | USD | 2.059 | 0,67 | 2.955 | 0,89 |
| US7739031091 - ACCIONES ROCKWELL | USD | 321 | 0,10 | 307 | 0,09 |
| US2910111044 - ACCIONES EMERSON ELECTRIC | USD | 559 | 0,18 | 631 | 0,19 |
| US8168511090 - ACCIONES SEMPRA ENERGY | USD | 609 | 0,20 | 657 | 0,20 |
| US0382221051 - ACCIONES APPLIED MATERIALS | USD | 920 | 0,30 | 1.062 | 0,32 |
| US7475251036 - ACCIONES QUALCOMM | USD | 1.638 | 0,53 | 1.818 | 0,55 |
| US1491231015 - ACCIONES CATERPILLAR | USD | 1.118 | 0,36 | 1.349 | 0,41 |
| AN8068571086 - ACCIONES SCHLUMBERGER | USD | 656 | 0,21 | 692 | 0,21 |
| US17275R1023 - ACCIONES CISCO SYSTEMS | USD | 2.139 | 0,69 | 2.426 | 0,73 |
| US8825081040 - ACCIONES TEXAS INSTRUMENTS | USD | 1.826 | 0,59 | 1.884 | 0,57 |
| US1941621039 - ACCIONES COLGATE PALMOLIVE | USD | 757 | 0,25 | 930 | 0,28 |
| US1912161007 - ACCIONES COCA COLA | USD | 2.815 | 0,91 | 3.356 | 1,02 |
| US5949181045 - ACCIONES MICROSOFT | USD | 22.428 | 7,27 | 26.348 | 7,98 |
| US0200021014 - ACCIONES ALLSTATE | USD | 435 | 0,14 | 498 | 0,15 |
| US7427181091 - ACCIONES PROCTER & GAMBLE | USD | 3.895 | 1,26 | 4.656 | 1,41 |
| US30231G1022 - ACCIONES EXXON MOBIL | USD | 4.699 | 1,52 | 4.875 | 1,48 |
| US1101221083 - ACCIONES BRISTOL MYERS | USD | 1.960 | 0,64 | 2.272 | 0,69 |
| US9311421039 - ACCIONES WAL-MART STORES | USD | 2.387 | 0,77 | 2.353 | 0,71 |
| US4581401001 - ACCIONES INTEL | USD | 1.366 | 0,44 | 2.037 | 0,62 |
| US7170811035 - ACCIONES PFIZER | USD | 3.171 | 1,03 | 4.015 | 1,22 |
| US0028241000 - ACCIONES ABBOTT LABORATORIES | USD | 2.188 | 0,71 | 2.632 | 0,80 |
| TOTAL RV COTIZADA | | 278.768 | 90,36 | 316.560 | 95,83 |
| TOTAL RV NO COTIZADA | | 0 | 0,00 | 0 | 0,00 |
| TOTAL RV PENDIENTE ADMISIÓN A COTIZACIÓN | | 0 | 0,00 | 0 | 0,00 |
| TOTAL RENTA VARIABLE | | 278.768 | 90,36 | 316.560 | 95,83 |
| TOTAL IIC | | 0 | 0,00 | 0 | 0,00 |
| TOTAL DEPÓSITOS | | 0 | 0,00 | 0 | 0,00 |
| TOTAL ENTIDADES DE CAPITAL RIESGO + otros | | 0 | 0,00 | 0 | 0,00 |
| TOTAL INVERSIONES FINANCIERAS EXTERIOR | | 278.768 | 90,36 | 316.560 | 95,83 |
| TOTAL INVERSIONES FINANCIERAS | | 278.768 | 90,36 | 316.560 | 95,83 |

Notas: El período se refiere al final del trimestre o semestre, según sea el caso.

Los productos estructurados suponen un 0,00% de la cartera de inversiones financieras del fondo o compartimento.

11. Información sobre la política de remuneración

No aplica en este informe

12. Información sobre las operaciones de financiación de valores, reutilización de las garantías y swaps de rendimiento total (Reglamento UE 2015/2365)

No existe información sobre operaciones de financiación de valores, reutilización de las garantías y swaps de rendimiento total